

## 《金融市场创新与风险管理》课程大纲（两天）

课程介绍：

本课程围绕金融市场创新主体，从金融市场基础入手讲述了金融创新的基础、工具，同时结合相关工具特征解析金融风险管理的具体操作和化解方法，符合有一定金融基础的学员与相关岗位工作人员学习和修读。

本课程根据公司的行业特征与学员特征，或许会酌情增补衍生品相关基础知识部分；风险管理涵盖的内容其实不是特别的多，核心还是围绕着金融市场工具与运作，及其相关风险来设计。

专题一：《金融市场概述——金融创新的角度》

- 金融市场基本概述—金融的逻辑（基本分析框架）
- 金融市场的基本结构（基本市场结构介绍）
  - 股票、货币、债券
  - 外汇、基金、保险
  - 衍生品（金融衍生品与其他介绍）
- 中国金融市场的思维逻辑——货币金融逻辑
- 中国金融市场前沿问题：金融科技（提供前瞻性的解读）

专题二 《金融创新——传统金融工具与金融风险》

- 金融创新的种类与动因：法律、制度、税收
- 金融创新的主要内容：案例解读
- 基础金融工具：创新与风险
  - 远期、期货、期权、互换
  - 创新风险案例：期货、期权与互换案例
- 衍生金融工具：创新与风险
  - 股权衍生品—股指期货、股票期权、权证及其风险
  - 债券衍生品—可转债、结构化产品等
- 其他特殊工具：指数与大宗商品工具风险
  - 波罗的海指数、天气指数等
  - 大宗商品：贵金属、铁矿石
  - 石油及其相关衍生品

专题三：《金融创新——新工具运用》

- 金融创新工具
- ABS 设计案例讨论
- Reits 案例
- CDS 风险案例
- CDR

专题四：金融风险总结：从融资租赁角度把握

- 金融市场风险
  - 1、信用风险(Credit risk)
  - 2、市场风险(Market risk)
  - 3、流动性风险(Liquidity risk)
  - 4、操作风险(Operational risk)——经营风险
  - 5、法律风险(Law risk)
  - 6、国家风险(Country risk)等等

- 风险管理方法：基本 Var 法则应用案例
- 风险管理技术：估值技术应用